Manual de Usuario

Perfil de usuario "BROKER"



Marzo 2013

Elaborado por: Profesional de Operaciones y soporte Técnico SET-FX	Revisado por: Gerente de TI	Aprobado por: Presidente FX
Fecha : 06/03/2013	Fecha: 11/03/2013	Fecha: 11/03/2013

INDICE

Objetivo

El presente Manual tiene como objeto explicar de forma detallada las funcionalidades existentes para el registro de operaciones a traves del Perfil Broker aprobado en el Reglamento del Sistema SET-FX (en adelante el "Sistema") por la Superintendencia Financiera de Colombia mediante la Resolución 1655 del 12 de octubre de 2012.

El Perfil Bróker dará acceso a los brokers al aplicativo de Registro del SET-FX con el objetivo de ingresar el registro de las operciones que celebren los Intermediarios del Mercado Cambiario (en adelante "IMC") con otros IMC y/o con sus clientes del sector real, vigilados por la Superintendencia Financiera de Colombia, o con la calidad de agentes del exterior.

Funcionalidades

Desde el Perfil Bróker es posible registrar en los siguientes mercados, todos los que se encuentran autorizados en el Reglamento del Sistema:

<u>IMC con otros IMC</u>

- Spot: todas las monedas
- Next Day:todas las monedas
- Forward: todas las monedas
- Swap: todas las monedas
- IRS/CCS: todas las monedas
- Opciones: todas las monedas
- Otros Derivados: todas las monedas

<u>Entre IMC y sus clientes del sector real, vigilados</u>por la Superintendencia Financiera de Colombia, o con la calidad de agentes del exterior:

- Spot: todas las monedas
- Next Day: todas las monedas
- Forward: todas las monedas
- Swap: todas las monedas
- IRS/CCS: todas las monedas
- Opciones: todas las monedas
- Otros Derivados: todas las monedas

Para cada uno de estos mercados el Sistema dispone de una ventana que despliega todos los campos que deben ser diligenciados por el usuario de Perfil Bróker para las operaciones de registro, contra previa instrucción expresa del Afiliado al Sistema.

Una vez el Perfil Bróker complete la información solicitada por el Sistema, un mensaje será enviado al Afiliado IMC que dio la instrucción de registro, para su confirmación. Si no hay confirmación del Afiliado sobre la operación registrada, se considerará que no hay registro en firme.

Condiciones

- Las operaciones en los mercados USD – COP harán uso de los cupos tanto bilaterales como cupos Cámara de Compensación de Divisas (CCD) asignados por las contrapartes y dependerá directamente de la disponibilidad y configuración de los mismos para su aceptación.

- Los registros entre IMC Afiliados al Sistema, requieren la confirmación de ambas contrapartes.

- El registro de una operación realizada entre un IMC y una entidad no Afiliada al Sistema requerirá de la confirmación por parte el IMC para completar el proceso de registro de dicha transacción.

- El Perfil Bróker solo podrá ingresar información para el registro de operaciones contra expresa instrucción de un Afiliado; la anulación o modificación de tales operaciones, será responsabilidad de los IMC involucrados en la operación, siguiendo los mecanismos actuales para este proceso.

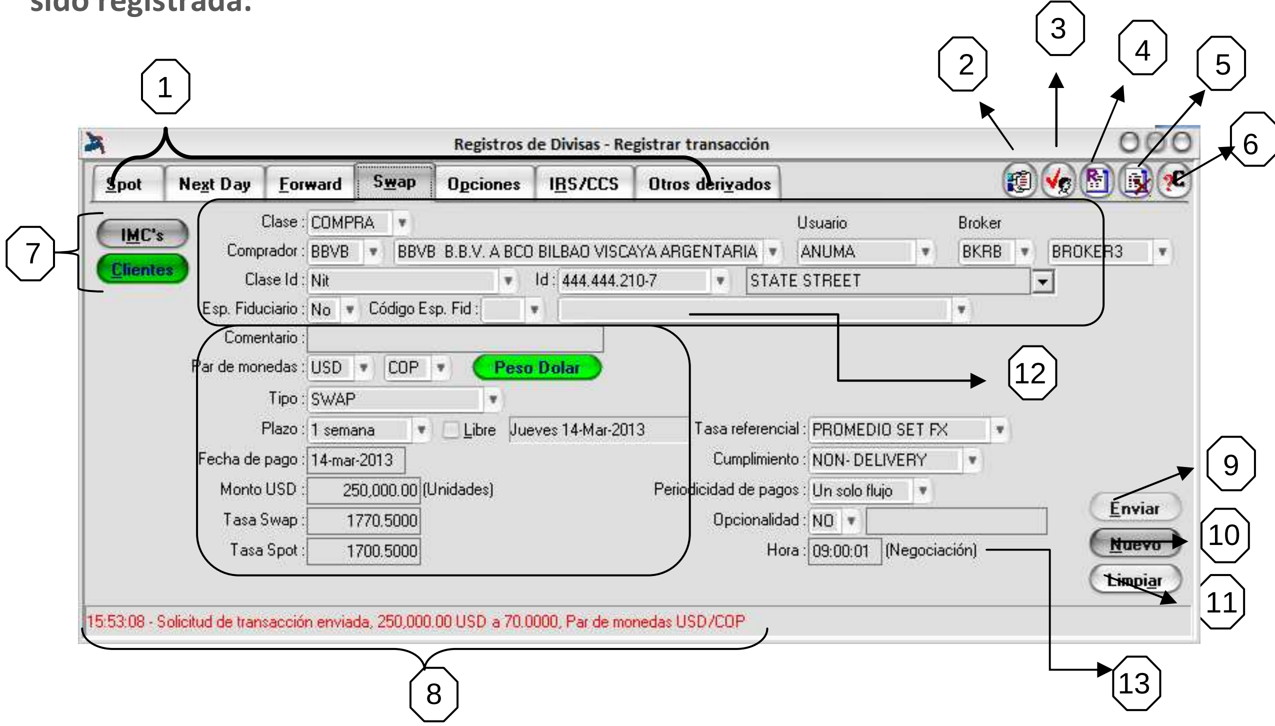
Ingreso al modulo Registro Perfil Broker

Para ingresar al módulo de “Registros del Perfil Bróker”, el usuario con dicho perfil debe ingresar en el botón “Mercados” y posteriormente en la sección “Registros de Divisas”, cómo se muestra a continuación:



A continuación, se desplegará una ventana donde se identifican los mercados disponibles en este módulo (Spot, NextDay, Forward, Swap, IRS/CCS, Opciones, y Otros Derivados), como se muestra en la siguiente gráfica:

Funcionalidad de los botones en todos los mercados una vez la operación ha sido registrada:



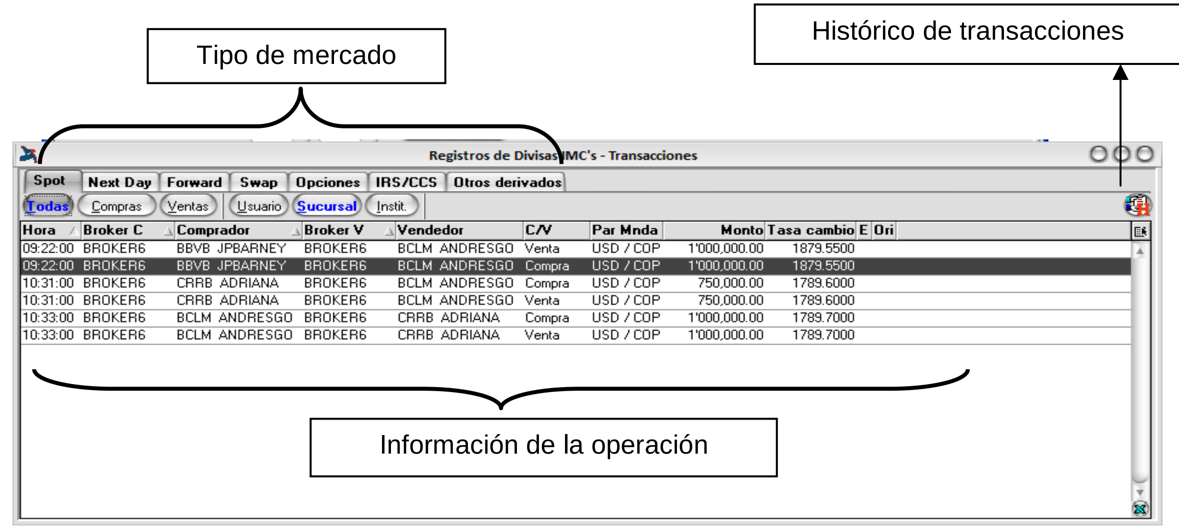
1. Mercados: Spot / Next Day /Forward / Swap / Opciones / IRS-CCS / Otros Derivados.

2. El Botón Precios/montos de transacciones propias permite visualizar las operaciones registradas; generando información referente al mercado activo en el momento de usarlo, con clic sobre este botón se despliegan dos opciones: IMC's y Clientes



Al seleccionar una de estas opciones se muestra la información de las operaciones registradas a través del Perfil Bróker en cada mercado seleccionado (Intermediarios del Mercado Cambiario "IMC's" – Otros "Clientes").

Cuando se seleccione la opción "IMCs", el Perfil Bróker visualizará:



(Gráfica No. 1)

Y, cuando el Perfil Bróker seleccione la opción "Clientes", visualizará lo siguiente:



(Gráfica No. 2)

Como se señala en la Gráfica No. 1, desde la ventada de visualización de las operaciones registradas, el Perfil Bróker tendrá la opción de acceder a la información histórica de las transacciones realizadas en los diferentes mercados, haciendo clic en el botón, el cual desplegará la siguiente ventana;



(Gráfica No. 3)

3. Botón comitente: cuando se selecciona ésta opción se despliega una lista de los agentes del extranjero agrupadas alfabéticamente al seleccionar la letra inicial del nombre de dicha entidad.

La base de datos de los agentes del exterior corresponde a la que ha sido generada por SET-ICAP FX S.A. de acuerdo con la información que ha sido suministrada por los Afiliados al Sistema cuando quiera que se realice un registro de una operación celebrada con tales entidades.

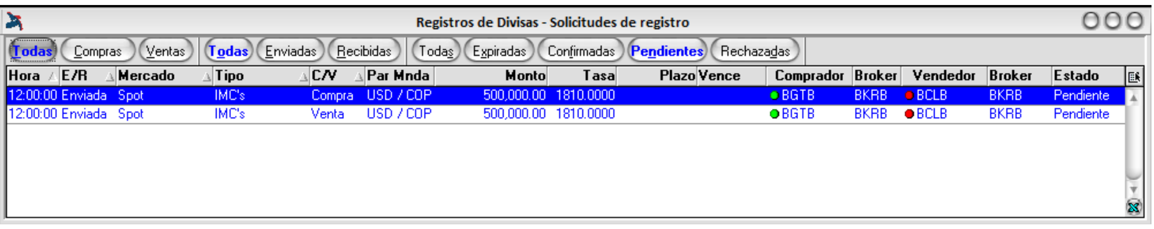
Comitentes

A B C D E F G H I J K L M N O P Q R S T U V W X Y Z 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 .

Código	Nombre	Tipo Entidad	Sector
X - 001	AFEX MONEY EXPRESS	Agentes del Exterior	6716
X - 002	AMERICAN EXPRESS BANK	Agentes del Exterior	6512
X - 003	AMERICANA DE SERVICIOS OF MIAMI INC	Agentes del Exterior	6716
X - 004	ARGENPER S.A.	Agentes del Exterior	6716
X - 005	ASSOCIATED FOREING EXCHANGE INC.	Agentes del Exterior	6715
N - 900.224.292-0	A.L. CARBONELL & CIA SCA	Agentes del Exterior	90

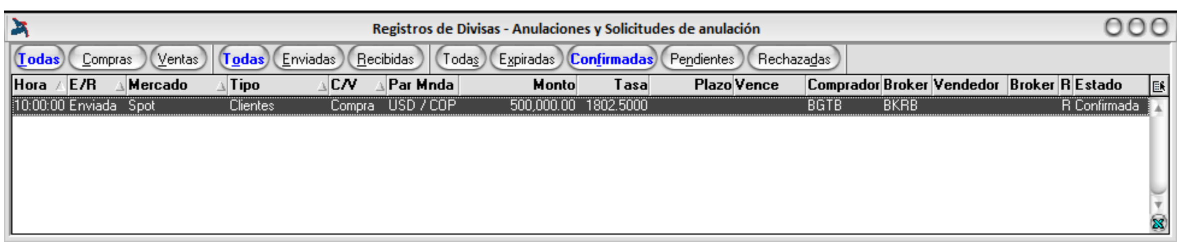
(Gráfica No. 4)

4. Dando clic en el botón de "Solicitudes de Registro" Solicitudes de Registro, el Sistema desplegará la información de los registros enviados tanto para compra como para venta y el estado en el que se encuentran con respecto a la aceptación de las partes implicadas. El indicador de aceptación del registro es la luz en "verde "bajo la columna comprador y/o vendedor; la luz "roja" significa que el registro está pendiente por ser aceptado durante el periodo de 15 minutos a partir del momento en que sea enviado el registro.



(Gráfica No. 5)

5. La opción de "Anulaciones y Solicitudes de Anulación" Anulaciones y Solicitudes de anulación, dará acceso al Perfil Bróker a la información de las operaciones anuladas durante la jornada, o las solicitudes de anulación. Las anulaciones solo pueden ser enviadas por las partes implicadas IMC Afiliados al Sistema.



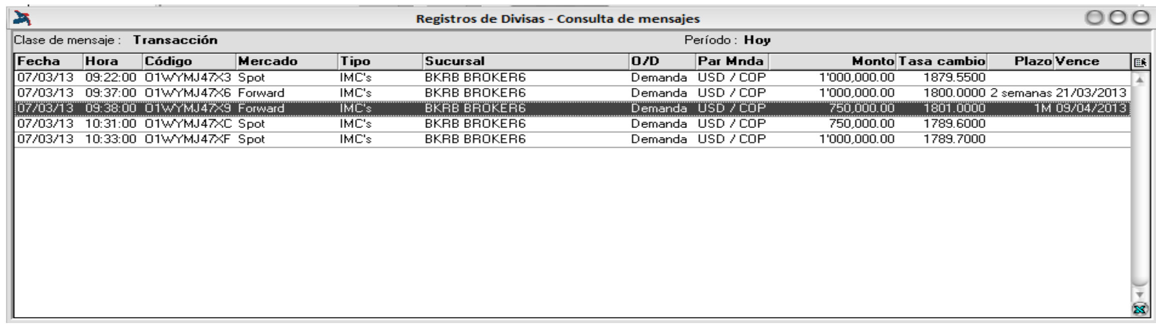
(Gráfica No. 6)

6. El botón de "Consultas" Consultas permite al Perfil Bróker realizar consultas sobre las transacciones y anulaciones realizadas en el mercado Registro desde el Perfil Bróker. Para acceder a dicha información, el Perfil Bróker deberá determinar el Periodo, la Clase de Mensaje y la Sucursal:



(Gráfica No. 7)

Una vez seleccionada la información requerida por el aplicativo, al hacer clic en Consultar, el Sistema mostrará la información según los parámetros seleccionados para la consulta, como se muestra en la siguiente ventana:



Fecha	Hora	Código	Mercado	Tipo	Sucursal	O/D	Par Mnda	Monto	Tasa cambio	Plazo	Vence
07/03/13	09:22:00	01WYMJ47X3	Spot	IMC's	BKRB BROKER6	Demanda	USD / COP	1'000,000.00	1879.5500		
07/03/13	09:37:00	01WYMJ47X6	Forward	IMC's	BKRB BROKER6	Demanda	USD / COP	1'000,000.00	1800.0000	2 semanas	21/03/2013
07/03/13	09:38:00	01WYMJ47X9	Forward	IMC's	BKRB BROKER6	Demanda	USD / COP	750,000.00	1801.0000	1M	09/04/2013
07/03/13	10:31:00	01WYMJ47XC	Spot	IMC's	BKRB BROKER6	Demanda	USD / COP	750,000.00	1789.6000		
07/03/13	10:33:00	01WYMJ47XF	Spot	IMC's	BKRB BROKER6	Demanda	USD / COP	1'000,000.00	1789.7000		

(Gráfica No. 8)

7. Para realizar un Registro, el Perfil Bróker deberá seleccionar el botón de "IMC´s" o "Clientes", dependiendo del tipo de operación a registrar. Esta opción va a ser persistente – si el Bróker hace clic en la viñeta Spot y la última transacción que hizo en el Spot fue entre"IMC´s", el botón correspondiente, es decir "IMC's" permanecerá seleccionado y se mostrara en color verde:



8. En estos campos el Perfil Bróker deberá diligenciar la información de la contraparte a quien se le enviara el registro y su posición en la operación, es decir, si compra o venta. El espacio para Comentarios es opcional.

9. Una vez la totalidad de la información requerida ha sido completada, se activa el botón de "Enviar". Este botón envía el pedido de registro en las contrapartes en los términos acá establecidos.

10. Para ingresar un nuevo registro, se puede hacer clic en "Nuevo" para activar todos los campos requeridos antes descritos, y deja los valores del registro anterior, es decir deja los valores de la operación antes enviada.

11. El Perfil Bróker tendrá además la opción de borrar los datos en todos los campos requeridos, dejándolos disponibles para una nueva operación, dando clic en el botón de "Limpiar".

12. El Perfil Bróker deberá ingresar en el campo "Par de monedas" las divisas sobre las cuales se cerró la operación objeto de registro, una vez seleccionado el par de monedas para un registro, van a aparecer los códigos de tres letras de las monedas; en el campo "Monto CHF" deberá ingresar en Unidades, el monto de la transacción; y finalmente, en el campo de "Tasa de cambio" identificará la tasa de cambio a la cual operaron las partes.

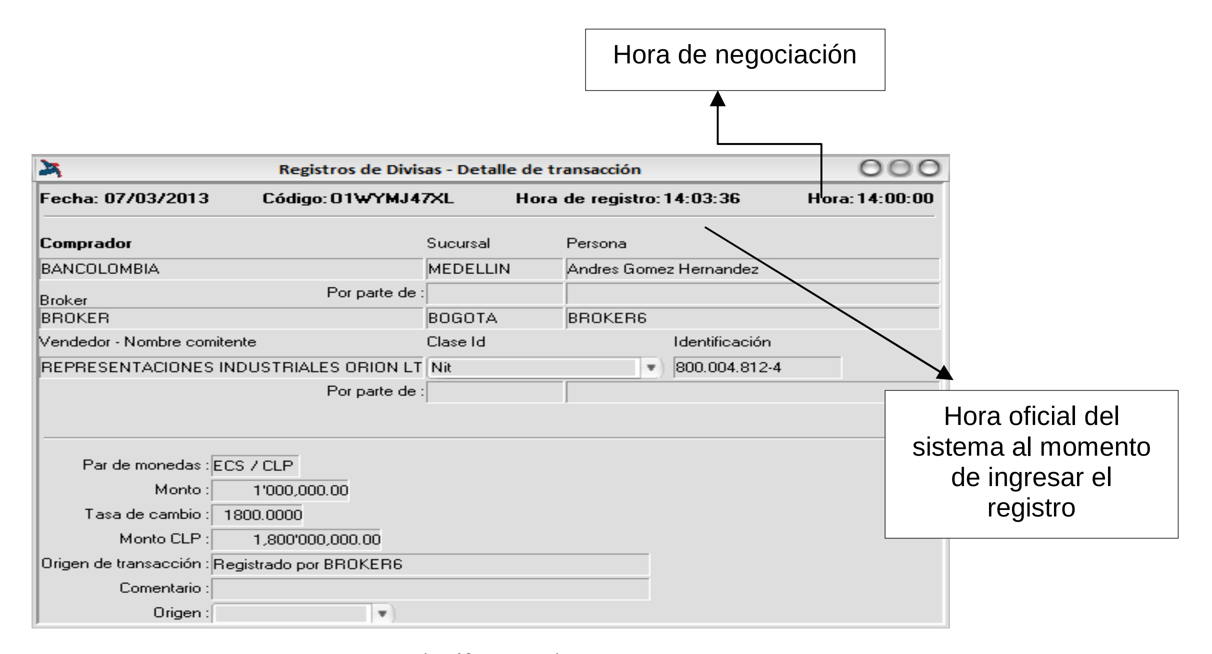
    Campo "Clase" tipo de operación (Compra/venta, Pull de compra etc) depende del mercado

    Campo **"Hecho Por"**, donde se puede seleccionar 3 tipos de usuarios:

    - Yo: Es el usuario que posee la aplicación SET-FX quien registra la operación
    - Usuario SET-FX: Cualquier otro usuario de la institución que posee aplicativo SET-FX
    - Otro: Cualquier empleado de la institución y que no posee aplicativo SET-FX

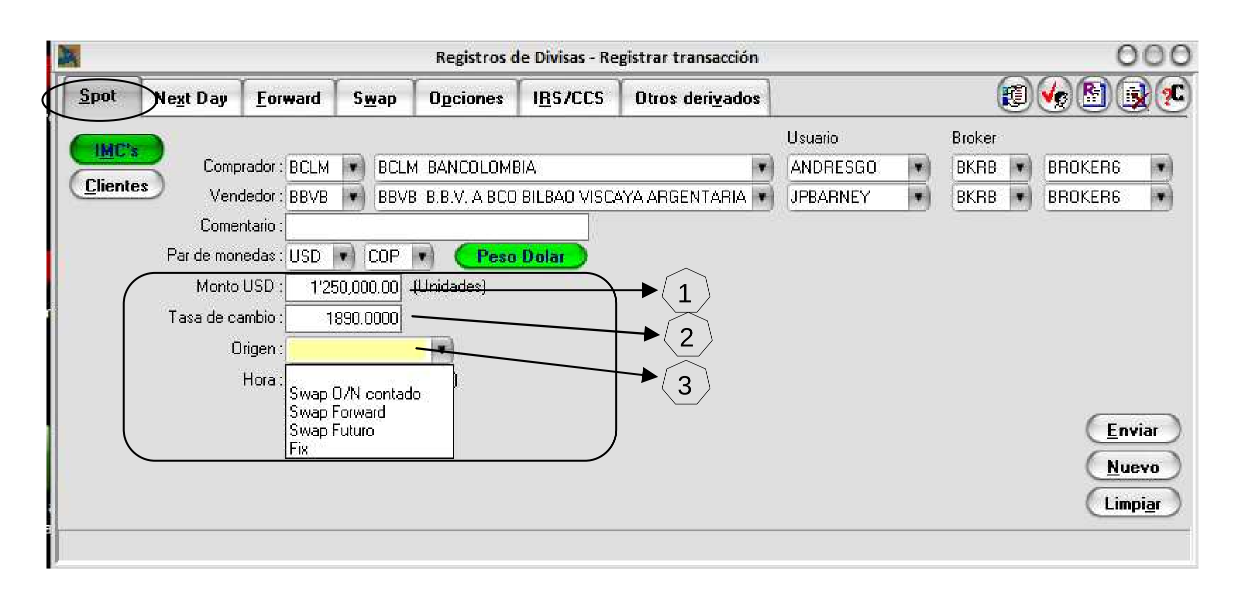
13. En el campo de "Hora de Negociación "el Perfil Bróker deberá ingresar manualmente la hora en la que la operación fue cerrada por el Afiliado, dicha información debe ser suministrada por el Afiliado al usuario de Perfil Bróker. Esta información es de carácter obligatorio.

Finalizado el proceso de ingreso y envío de la operación registrada a los Afiliados, el Perfil Bróker podrá revisar en la ventana de “Consulta de Mensajes” el detalle de la operación, haciendo clic derecho sobre cualquiera de ellas:



(Gráfica No. 9)

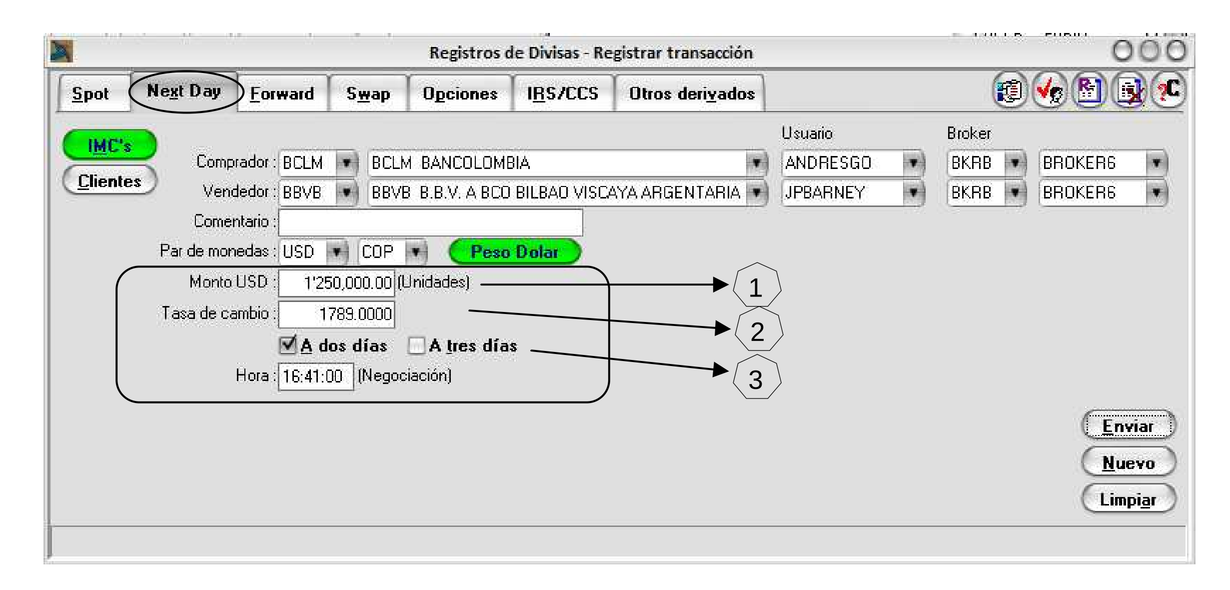
Registro de operaciones Spot entre IMCs:



1.- Monto de la operación en unidades
2.- Tasa de cambio
3.- Origen. Este campo es utilizado para identificar de donde proviene el spot a registrar, este puede tener las siguientes opciones:

- Empty para Spot
- Swap O/N contado
- Swap Forward
- Swap Futuro
- FIX.

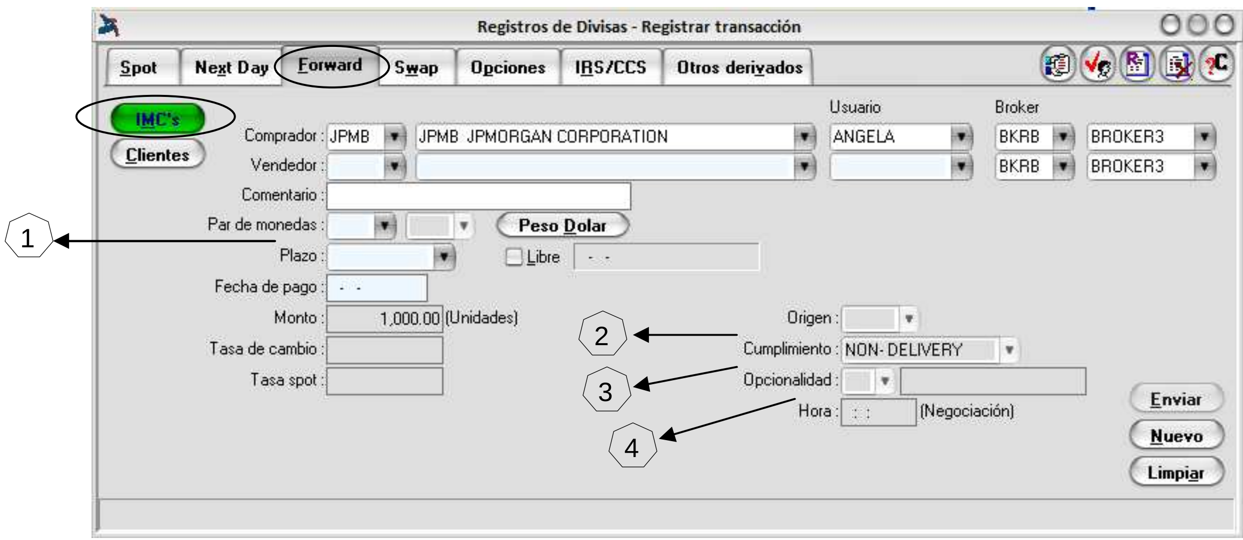
Registro de operaciones NextDay entre IMCs:



1.- Monto de la operación en unidades
2.- Tasa de cambio
3.- Vencimiento: Plazo del nextday, este puede ser a un día (por default), dos días o tres días.

Registro de operaciones Forward entre IMCs:

En el mercado Forward, el usuario Perfil Bróker deberá diligenciar campos adicionales a los descritos en para el mercado Spot y Next Day, como se indica a continuación:



(Gráfica No. 10)

- La opción de "Plazo" podrá ser uno de los predefinidos para los mercados SWAP y FORWARD Plazo : 2 Semanas Libre Martes 02-Feb-2010, o podrá ser un plazo libre Plazo : 21 Libre Martes 09-Feb-2010 elegido por el Perfil Bróker.

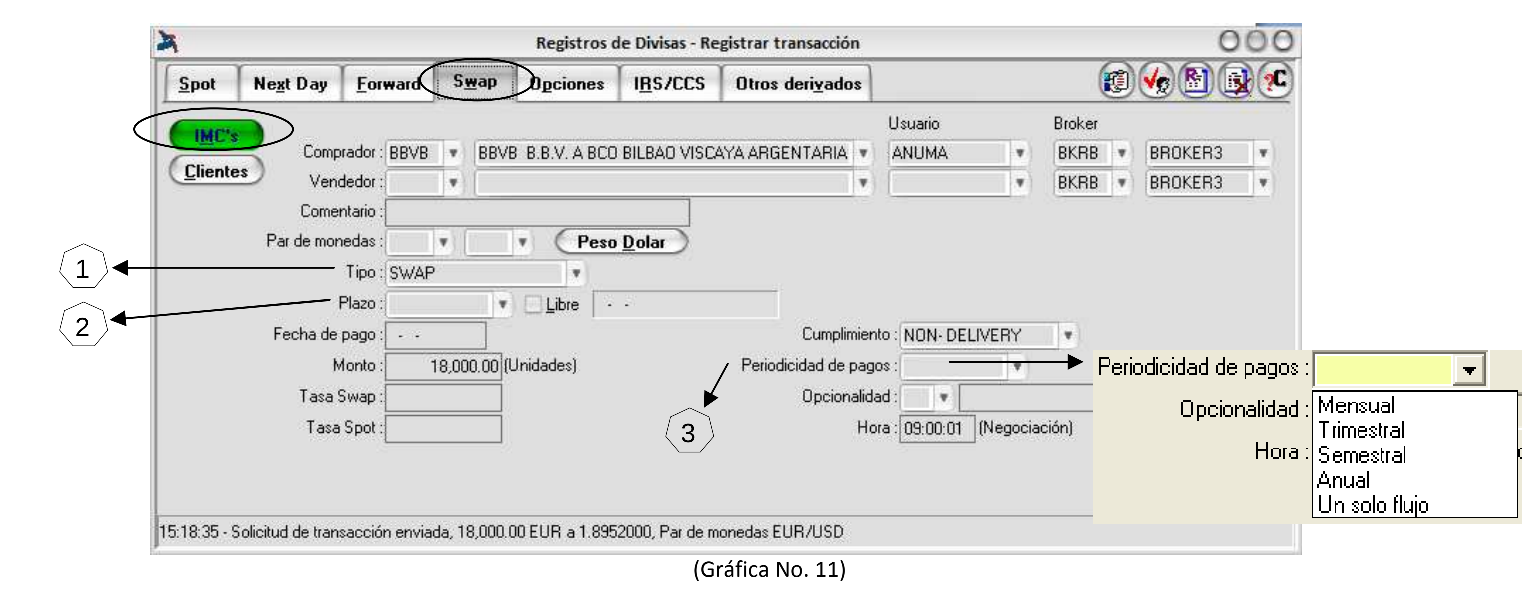
- El Perfil Bróker deberá indicar en el campo de "Cumplimiento" si éste es Delivery o Non-Delivery: Cumplimiento : NON- DELIVERY - Cumplimiento : DELIVERY

- En el campo de "Opcionalidad" el Perfil Bróker deberá marcar Opcionalidad : NO o Opcionalidad : SI . Cuando se marque "SI" será porque tiene una opción implícita en operación acordada entre las partes y deberá ingresar la información correspondiente en el campo respectivo que se habilitará.

- En el campo de "Hora" Hora : 08:02:00 se deberá incluir la hora en que se acordó el registró entre las contrapartes, información que debe ser suministrada por el Afiliado que da la orden de Registro, al igual que en el mercado Spot y/o Next Day.

Registro de operaciones Swap entre IMCs:

En el mercado Swap, el usuario Perfil Bróker deberá diligenciar campos adicionales a los descritos en la sección anterior para el mercado Spot y Next Day, como se indica a continuación:



(Gráfica No. 11)

1 El Perfil Bróker deberá ingresar en la opción "Tipo" si la operación se trata de Tipo : SWAP o Tipo : FORWARD FORWARD .

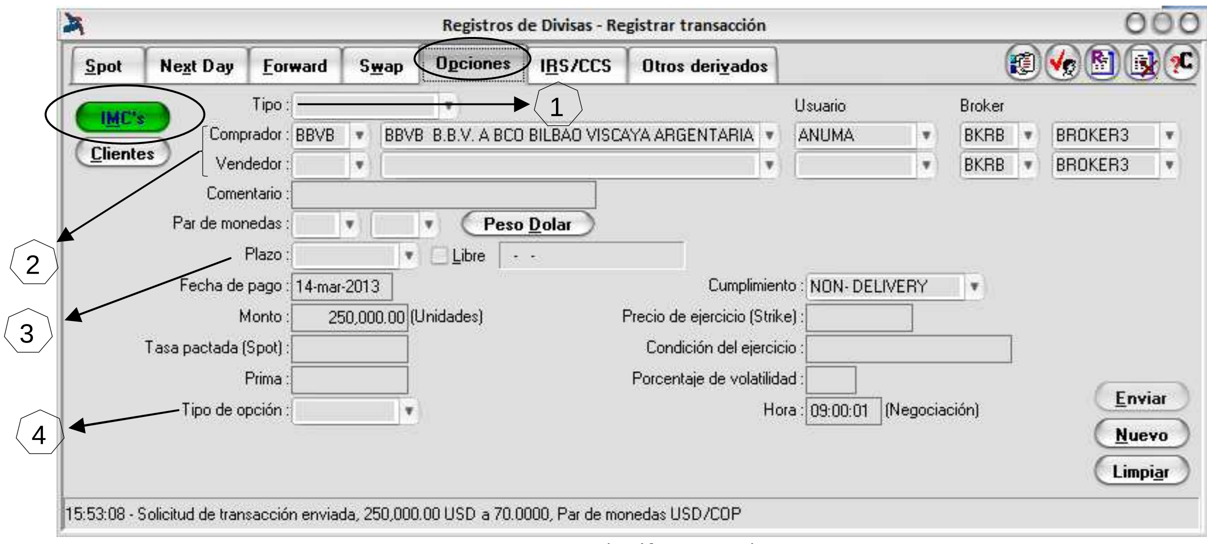
2 Cuando se ha seleccionado "FORWARD-FORWARD", la casilla de "Plazo" cambia por: Plazo : X

Cuando la operación es "SWAP" la casilla de "Plazo" cambia a: Plazo : 2 Semanas Libre Martes 19-Ene-2010 , la cual podrá corresponder a los plazos preestablecidos en el Sistema o a un plazo libre Plazo : 21 Libre Martes 09-Feb-2010

3 La "Periodicidad de pagos" será predefinida en el Sistema y seleccionada al momento de registrar una operación

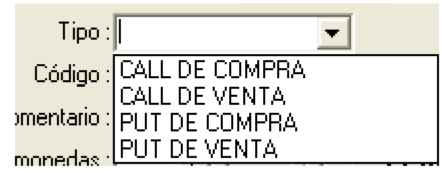
Registro de Opciones entre IMCs:

Para las Opciones, el usuario Perfil Bróker deberá diligenciar campos adicionales a los descritos para el mercado Spot y Next Day, como se indica a continuación:



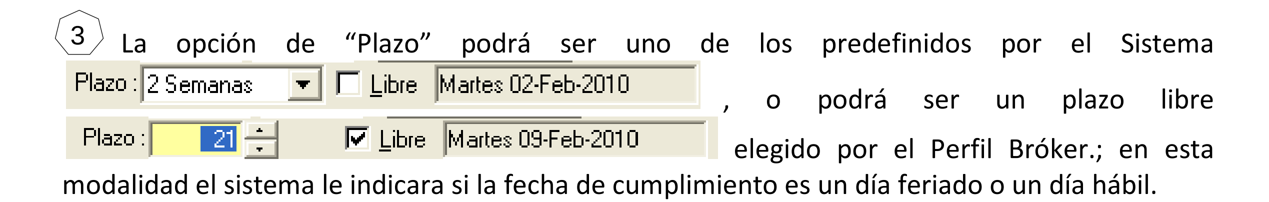
(Gráfica No. 12)

1 En el campo de “Tipo”, el Sistema desplegará las opciones de: “Call de Compra”, “Call de Venta”, “Put de Compra” y “Put de venta:



2 En los campos de “Comprador” y “Vendedor” se debe seleccionar la contraparte siguiendo los códigos creados en el Sistema, los cuales se crean por tres letras que se asignan a la entidad y una cuarta que indica la sucursal, ejemplo: Bancolombia sucursal Bogotá; BCLB; y el usuario al que se le enviara la solicitud de registro.

3 La opción de “Plazo” podrá ser uno de los predefinidos por el Sistema



, o podrá ser un plazo libre elegido por el Perfil Bróker.; en esta modalidad el sistema le indicara si la fecha de cumplimiento es un día feriado o un día hábil.

4 En el campo tipo de opción el sistema nos permite seleccionar si la opción es:

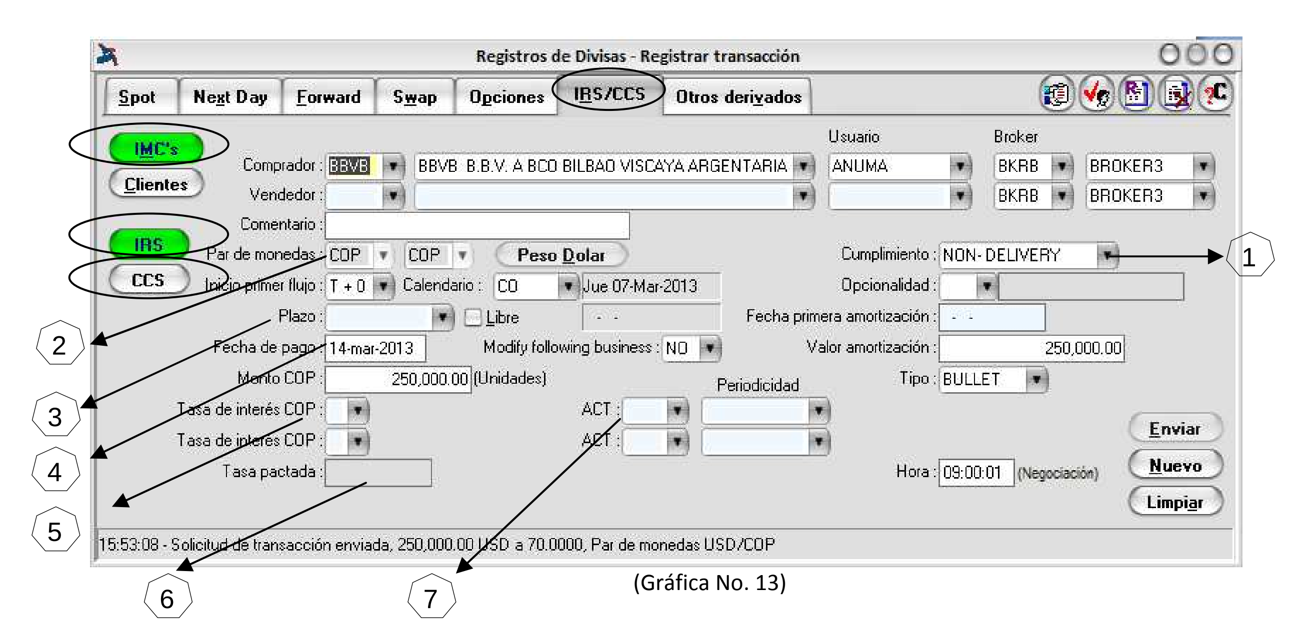


- Una vez se hayan completado todos los campos el botón de Enviar se activará y podrá ser enviada la solicitud de registro a la contraparte para su respectiva confirmación.

- Para una operación en monedas Peso/Dólar se debe hacer clic en el botón Peso Dolar y realizar el registro diligenciando los campos antes mencionados.

Registro de operaciones IRS/CCS (Interest rate Swaps / Cross currency swap) entre IMCs:

Para las operaciones de IRS y CCS, el usuario Perfil Bróker deberá diligenciar campos adicionales a los descritos para el mercado Spot y Next Day, como se indica a continuación:



(Gráfica No. 13)

1 Los registros IRS/CCS pueden tomar valores para su cumplimiento: DELIVERY o NON-DELIVERY.

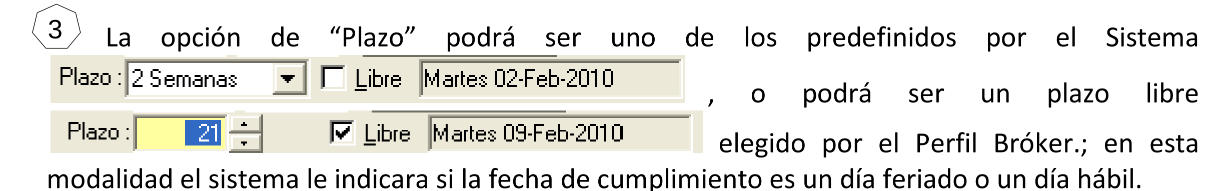


2 En el campo “Par de monedas”, se podrá seleccionar “Peso Dólar ”u“ Otras monedas”

- Para realizar un registro en Peso Dólar, se debe seleccionar la opción correspondiente como se muestra en la Gráfica No. 13. Si es en otra moneda ésta opción se deshabilitará:



Peso Dolar

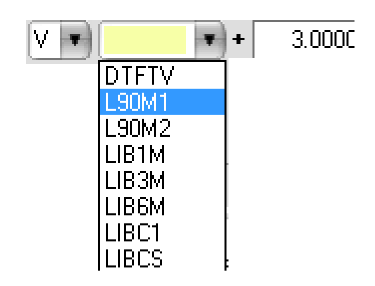


3 La opción de “Plazo” podrá ser uno de los predefinidos por el Sistema , o podrá ser un plazo libre elegido por el Perfil Bróker.; en esta modalidad el sistema le indicara si la fecha de cumplimiento es un día feriado o un día hábil.

- Una vez se hayan completado todos los campos el botón de Enviar se activará y podrá ser enviada la solicitud de registro a la contraparte para su respectiva confirmación.

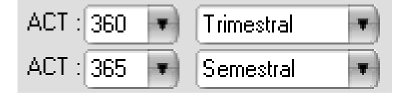
4 La opción de fecha de pago es editable, si es una operación entre dos IMC’s, será un día hábil después del cumplimiento y si es una operación entre un IMC’s y un offshore, serán dos días hábiles. Esta fecha no puede ser inferior a la fecha de vencimiento.

5 Tasa de interés: Estas tasas pueden ser F - Fijo / V - Variable y son excluyentes. Para el caso de seleccionar la tasa fija se habilitará el campo para ingresar el valor de la tasa. F 1.300000% Y para el caso de la tasa variable, se habilitara una lista con las tasas de interés que opera el mercado, seguido de un campo para ingresar un spread, si es el caso.



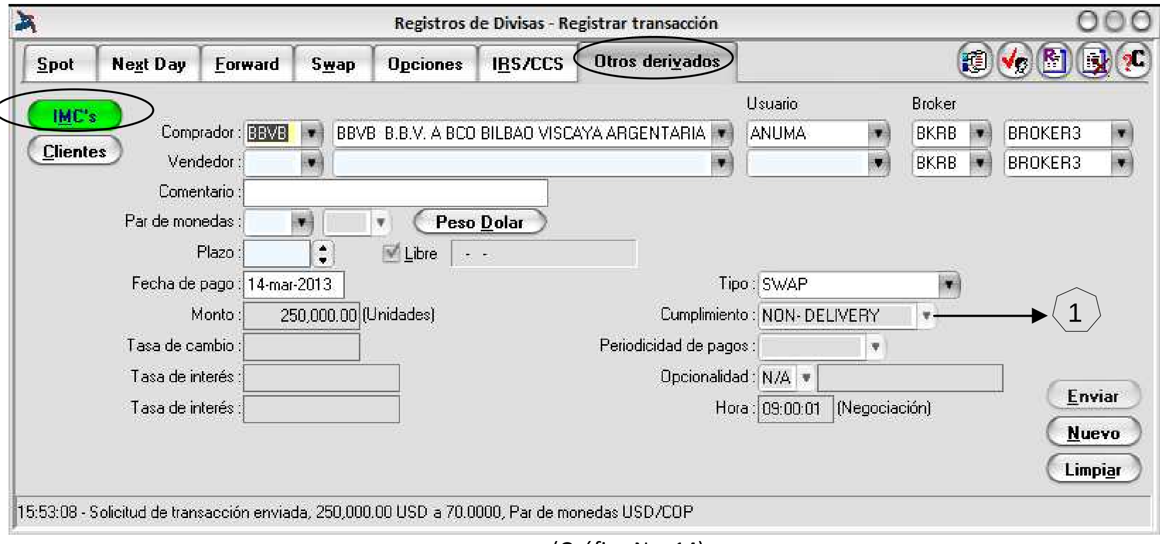
6 Tasa pactada: Para operaciones IRS este campo estará deshabilitado y para operaciones CCS, estará habilitado para ingresar la tasa.

7 ACT: Para cada tipo de tasa de interés, se debe ingresarse en estos campos el calendario que puede ser 360 o 365, adicionalmente la periodicidad de pago de cada tasa: Mensual, Trimestral, Semestral, Anual, Un Solo flujo.



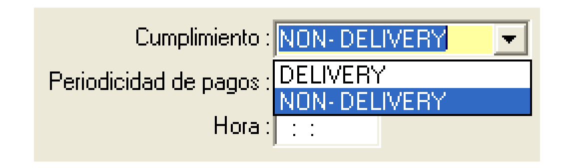
Registro de Otros Derivados entre IMCs:

Para los Derivados, el usuario Perfil Bróker deberá diligenciar campos adicionales a los descritos en la sección para el mercado Spot y Next Day, como se indica a continuación:



(Gráfica No. 14)

1 Los registros en “Otros derivados” tienen la posibilidad en su cumplimiento de ser: DELIVERY o NON-DELIVERY.



- Una vez se hayan completado todos los campos el botón de Enviar se activará y podrá ser enviada la solicitud de registro a la contraparte para su respectiva confirmación.

Registro de Operaciones entre un Afiliado y un No Afiliado (Clientes):

Contrario a lo que ocurre para las operaciones que se celebran entre dos IMCs y que son objeto de registro en el Sistema a través del Perfil Bróker, cuando una de las contrapartes de la operación no es Afiliada al Sistema, el usuario Perfil Bróker deberá llevar a cabo el registro de la misma a través de la opción de "Clientes" resaltada en la Gráfica No. 15.

Una vez completada la información y enviada para el registro, la operación solo requiere confirmación de una contraparte, por lo cual se muestran los campos de identificación de los comitentes (Clientes) para todos los mercados.



(Gráfica No. 15)

- Los campos requeridos para cada mercado, son los mismos expuestos para operaciones entre IMC'S.

Control de cambios

Versión	Revisado-Responsable	Fecha de revisión	Aprobado	Fecha de aprobación	Razón
1	Gerente de TI	11/03/13			Documento inicial